

海通鑫悦债券型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 28 日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国民生银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2022 年 10 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 海通鑫悦 |
| 基金主代码 | 852300 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 95,496,683.86 份 |
| 投资目标 | 本集合计划采取稳健的资产配置策略，主要投资于固定收益类品种，强调资产配置的均衡，分散风险。严格管理权益类品种的投资比例，把握相对确定的股票二级市场投资机会。在风险可控的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券。</p> <p>2、目标久期策略及凸性策略</p> <p>在组合的久期选择方面，本集合计划将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本集合计划固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本集合计划的目标久期，即预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。 由于债券价格与收益率</p> |

之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本集合计划将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。

3、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强集合计划的收益。

4、信用债投资策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。获取信用利差超额收益。管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资和配置。

5、可转债投资策略

可转债主要筛选正股优良、估值合理及具备明显条款博弈价值的个券。根据转债估值及定价模型，结合权益市场预期进行择时判断，在市场估值及隐含波动率的不同阶段采用不同的投资策略；

个券筛选方面，择券主要抓手为正股资质，形成“行业-个股”的综合分析框架，并结合财务健康度识别信用风险，同时挖掘条款博弈价值；关注正股的右侧机会、绝对价格相对低位的优质标的的中长期配置、权益市场启动后低价个券的下修博弈价值

6、资产支持证券投资策略

本集合计划将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本计划的收益。

7、股票投资策略

在股票投资过程中，本集合计划将控制计划资产净值的波动幅度，特别是下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格管理股票的投资比例。

8、存托凭证投资策略

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| | <p>本集合计划将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>9、港股通标的股票投资策略</p> <p>本集合计划同时关注港股市场投资机会，将通过国内和香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本集合计划根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。</p> <p>10、国债期货投资策略</p> <p>本集合计划以套期保值为目的进行国债期货的投资，通过对现货市场和期货市场的分析，进行套期保值等策略操作。</p> <p>11、其它策略</p> <p>管理人根据市场的发展，以为客户最大化地获取收益为原则，可以在风控原则内前瞻性地运用其他策略。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+中证可转换债券指数*10%+沪深 300 指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | <p>本集合计划属于债券型集合资产管理计划，预期风险和收益水平低于股票型集合资产管理计划、股票型基金、混合型集合资产管理计划和混合型基金、高于货币型集合资产管理计划和货币市场基金。</p> <p>本集合计划可投资港股通标的的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> | |
| 基金管理人 | 上海海通证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 海通鑫悦 A | 海通鑫悦 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 852389 | 852300 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 88,687,111.42 份 | 6,809,572.44 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|--------------|
| | 海通鑫悦 A | 海通鑫悦 C |
| 1. 本期已实现收益 | -719,412.95 | -152,341.89 |
| 2. 本期利润 | -424,226.14 | -536,317.58 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0047 | -0.0113 |
| 4. 期末基金资产净值 | 91,084,124.96 | 6,960,475.79 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0270 | 1.0222 |

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通鑫悦 A

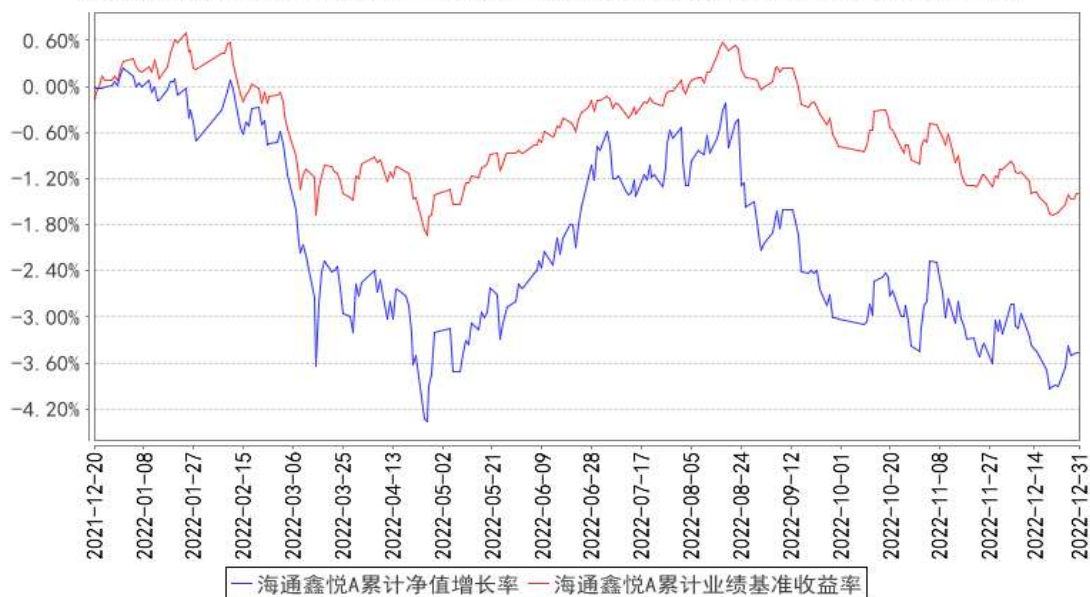
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.46% | 0.22% | -0.61% | 0.12% | 0.15% | 0.10% |
| 过去六个月 | -2.71% | 0.23% | -1.21% | 0.11% | -1.50% | 0.12% |
| 过去一年 | -3.69% | 0.25% | -1.70% | 0.13% | -1.99% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.47% | 0.25% | -1.39% | 0.13% | -2.08% | 0.12% |

海通鑫悦 C

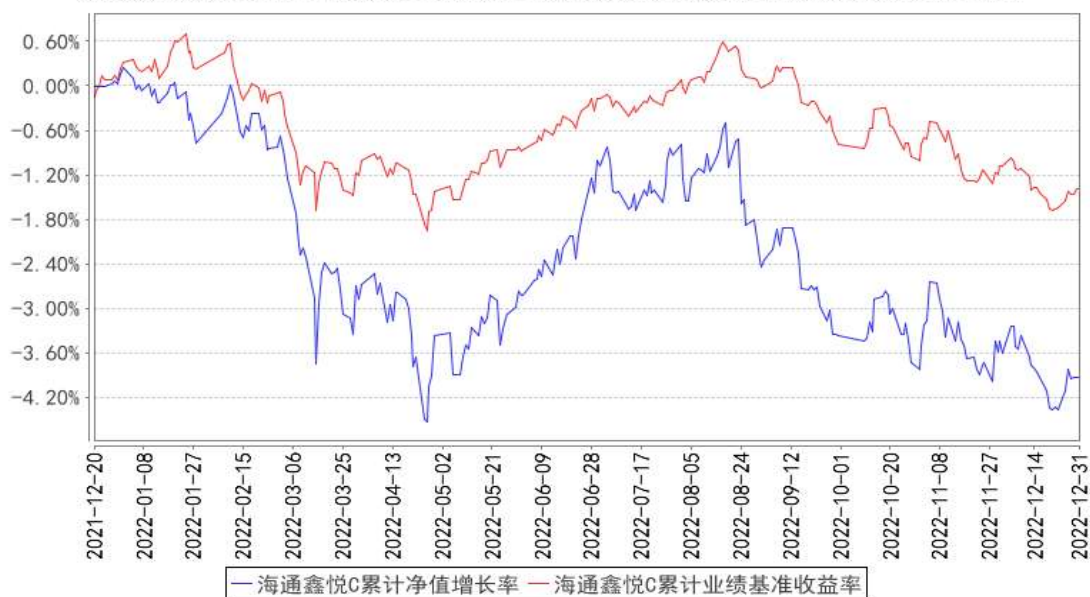
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.58% | 0.22% | -0.61% | 0.12% | 0.03% | 0.10% |
| 过去六个月 | -2.93% | 0.23% | -1.21% | 0.11% | -1.72% | 0.12% |
| 过去一年 | -4.14% | 0.25% | -1.70% | 0.13% | -2.44% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.92% | 0.25% | -1.39% | 0.13% | -2.53% | 0.12% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海通鑫悦A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通鑫悦C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李坤 | 投资经理 | 2021年12月20日 | - | 10年 | 李坤先生，复旦大学管理学硕士。曾任光大证券股份有限公司研究所研究员、平安资产管理有限责任公司信评与债券研究部研究员、上海海通证券资产管理有限公司投资经理及固定收益研究部研究副总监（主持工作）、固收三部副总监（主持 |

| | | | | | |
|----|------|------------------|---|-----|---|
| | | | | | 工作)。现任上海海通证券资产管理有限公司公募固收部副总监（主持工作）兼投资经理。 |
| 李夏 | 投资经理 | 2021 年 12 月 20 日 | - | 7 年 | 李夏，女，西安交通大学金融学和曼彻斯特大学统计学双硕士，7 年证券从业经验，2015 年加入上海海通证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员和投资经理，历任海通现金赢家，年年鑫，增益系列，慧享系列等产品投资经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项内部控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年四季度，宏观经济和政策环境均发生了比较明显的变化，导致债券市场和权益市场都经历了比较大的波动。由政策转向导致的复苏预期变化，使债券市场在 11 月走出一波快速且剧烈的调整行情，净值型理财的赎回负反馈对调整起到推波助澜的作用，信用利差大幅走阔，随后 12 月中下旬市场企稳。权益市场方面则经历了风格切换，同样因预期的变化，消费板块在四季度走出 V 字行情，而成长股则呈震荡下行态势。

鑫悦在四季度的业绩表现较为震荡，最终较季度初小幅下滑。仓位上，债券方面由于持仓债券久期较短，且信用债主要以好资质品种为主，在债券市场的调整中受伤并不严重，但持仓转债则因债券市场调整受到波及。权益方面，保持了此前较为均衡的行业持仓分布，在地产链、景气

成长行业和大消费行业均有布局，仓位在 12 月下旬有所抬升。

展望 2023 年，宏观经济面临内需复苏、外需下滑的组合，经济增速预计较 22 年有所抬升；流动性预计仍将保持合理充裕，以配合拉动经济复苏。这样的组合下，预计权益市场的全年表现将相对优于债券市场。债券市场方面，判断信用债的配置价值较好，而长久期利率债的交易难度加大，杠杆策略仍能贡献收益。权益市场方面，地产相关行业及线下消费行业预计将迎来经营拐点，部分成长行业如新能源预计仍将维持较高的景气度，均值得重点关注。鑫悦在 23 年一季度将较 22 年小幅增加权益敞口，债券方面将维持较短久期的配置思路，重视产品的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划 A 份额净值为 1.0270，C 份额净值为 1.0222。本报告期集合计划上述两类份额净值增长率为-0.46%和-0.58%，业绩比较基准收益率为-0.61%

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划于 2022 年 11 月 22 日至 2022 年 12 月 29 日出现了集合计划持有人数少于 200 人的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 15,188,791.65 | 14.35 |
| | 其中：股票 | 15,188,791.65 | 14.35 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 81,739,067.74 | 77.21 |
| | 其中：债券 | 81,739,067.74 | 77.21 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 3,861,000.00 | 3.65 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,090,675.29 | 1.03 |
| 8 | 其他资产 | 3,983,910.96 | 3.76 |
| 9 | 合计 | 105,863,445.64 | 100.00 |

注：本集合计划通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,904,451.65 元，占资产净值比例为

1.94%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,012.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 12,168,486.00 | 12.41 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 69,479.00 | 0.07 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,968.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 487,226.00 | 0.50 |
| J | 金融业 | 8,277.00 | 0.01 |
| K | 房地产业 | 546,000.00 | 0.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,892.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 13,284,340.00 | 13.55 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 基础材料 | - | - |
| 消费者非必需品 | - | - |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 461,373.96 | 0.47 |
| 医疗保健 | 384,106.10 | 0.39 |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | 1,058,971.59 | 1.08 |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |

| | | |
|----|--------------|------|
| 合计 | 1,904,451.65 | 1.94 |
|----|--------------|------|

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 30,000 | 1,155,900.00 | 1.18 |
| 2 | 002043 | 兔宝宝 | 80,000 | 868,800.00 | 0.89 |
| 3 | 001322 | 箭牌家居 | 50,000 | 760,000.00 | 0.78 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 20,000 | 693,600.00 | 0.71 |
| 5 | 300957 | 贝泰妮 | 4,500 | 671,580.00 | 0.68 |
| 6 | 000733 | 振华科技 | 5,700 | 651,111.00 | 0.66 |
| 7 | 00700 | 腾讯控股 | 2,000 | 596,704.36 | 0.61 |
| 8 | 002484 | 江海股份 | 25,000 | 559,250.00 | 0.57 |
| 9 | 000002 | 万科A | 30,000 | 546,000.00 | 0.56 |
| 10 | 002049 | 紫光国微 | 4,000 | 527,280.00 | 0.54 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 13,165,265.89 | 13.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,625,049.32 | 21.04 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,625,049.32 | 21.04 |
| 4 | 企业债券 | 20,610,213.41 | 21.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 8,293,674.52 | 8.46 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 19,044,864.60 | 19.42 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 81,739,067.74 | 83.37 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 180204 | 18 国开 04 | 100,000 | 10,422,920.55 | 10.63 |
| 2 | 220201 | 22 国开 01 | 100,000 | 10,202,128.77 | 10.41 |
| 3 | 143461 | 18 紫金 01 | 90,000 | 9,331,458.90 | 9.52 |
| 4 | 102100539 | 21 宣城国资 MTN001 | 80,000 | 8,293,674.52 | 8.46 |
| 5 | 132015 | 18 中油 EB | 60,000 | 6,361,865.75 | 6.49 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、国家外汇局上海市分局、上海市市场监督管理局和中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 56,108.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,926,307.12 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 489.92 |
| 6 | 其他应收款 | 1,005.90 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,983,910.96 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 132015 | 18 中油 EB | 6,361,865.75 | 6.49 |
| 2 | 110073 | 国投转债 | 2,100,893.15 | 2.14 |
| 3 | 110059 | 浦发转债 | 2,098,479.45 | 2.14 |
| 4 | 110079 | 杭银转债 | 813,432.60 | 0.83 |
| 5 | 127032 | 苏行转债 | 594,746.58 | 0.61 |
| 6 | 123108 | 乐普转 2 | 588,197.26 | 0.60 |
| 7 | 113047 | 旗滨转债 | 367,237.81 | 0.37 |
| 8 | 113055 | 成银转债 | 352,848.73 | 0.36 |
| 9 | 128121 | 宏川转债 | 304,750.68 | 0.31 |
| 10 | 111002 | 特纸转债 | 269,925.75 | 0.28 |
| 11 | 123144 | 裕兴转债 | 248,895.62 | 0.25 |
| 12 | 123145 | 药石转债 | 247,640.82 | 0.25 |
| 13 | 127063 | 贵轮转债 | 245,917.53 | 0.25 |
| 14 | 113625 | 江山转债 | 228,290.68 | 0.23 |
| 15 | 110076 | 华海转债 | 221,068.77 | 0.23 |
| 16 | 113601 | 塞力转债 | 215,928.77 | 0.22 |
| 17 | 113644 | 艾迪转债 | 213,069.04 | 0.22 |
| 18 | 127056 | 中特转债 | 210,599.73 | 0.21 |
| 19 | 118003 | 华兴转债 | 180,352.81 | 0.18 |
| 20 | 128078 | 太极转债 | 172,087.07 | 0.18 |
| 21 | 113626 | 伯特转债 | 113,662.40 | 0.12 |
| 22 | 113563 | 柳药转债 | 112,468.90 | 0.11 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海通鑫悦 A | 海通鑫悦 C |
|-------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 91,370,018.22 | 53,843,799.05 |

| | | |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,672.86 | 489.17 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,687,579.66 | 47,034,715.78 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 88,687,111.42 | 6,809,572.44 |

注:申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有),赎回含转换出份额(如有)。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本集合计划的管理人未持有本集合计划份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本集合计划的管理人未运用固有资金申赎及买卖本集合计划。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|------|---------------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| 机构 | 1 | 2022/11/22-2022/12/31 | 28,765,501.69 | - | - | 28,765,501.69 | 30.1200 |
| | 2 | 2022/10/01-2022/12/20 | 46,983,649.69 | - | 46,983,649.69 | - | - |
| | 3 | 2022/10/01-2022/12/31 | 46,884,002.50 | - | - | 46,884,002.50 | 49.0900 |

产品特有风险

报告期内,本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括: 1、当集合计划份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一集合计划份额持有人大额赎回而引发集合计划净值剧烈波动的风险; 2、若某单一集合计划份额持有人巨额赎回有可能引发集合计划的流动性风险,集合计划管理人可能无法及时变现集合计划资产以应对集合计划份额持有人的赎回申请,集合计划份额持有人可能无法及时赎回持有的全部集合计划份额。 3、若个别投资者大额赎回后,可能会导致集合计划资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险,集合计划可能会面临转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等情形。 4、其他可能的风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准海通年年升集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 海通鑫悦债券型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通鑫悦债券型集合资产管理计划托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站(www.htsamc.com)查阅,或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本集合计划管理人:上海海通证券资产管理有限公司
客户服务中心电话:95553

上海海通证券资产管理有限公司

2023 年 1 月 28 日